

建信双利策略主题分级股票型  
证券投资基金  
招募说明书（更新）  
2011年第2号

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

二〇一一年十二月

## 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2011年3月10日证监许可[2011]355号文核准募集。本基金合同已于2011年5月6日生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为2011年11月5日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年9月30日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

## 目 录

一、绪言 .....	5
二、释义 .....	6
三、基金管理人 .....	13
四、基金托管人 .....	22
五、相关服务机构 .....	29
六、基金份额分级 .....	38
七、基金的募集 .....	42
八、基金合同的生效 .....	47
九、建信稳健、建信进取的上市与交易 .....	48
十、基金份额的申购与赎回 .....	50
十一、场内份额的配对转换 .....	62
十二、基金的投资 .....	64
十三、基金的业绩 .....	80
十四、基金的财产 .....	82
十五、基金资产的估值 .....	84
十六、基金的收益分配 .....	91
十七、基金份额的折算 .....	92
十八、基金的费用与税收 .....	104
十九、基金的会计与审计 .....	106

二十、基金的信息披露 .....	107
二十一、风险揭示 .....	113
二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	117
二十三、基金合同的内容摘要 .....	120
二十四、基金托管协议的内容摘要 .....	138
二十五、对基金份额持有人的服务 .....	156
二十六、其他应披露事项 .....	159
二十七、招募说明书的存放及查阅方式 .....	161
二十八、备查文件 .....	162

## 一、绪言

《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）和其他有关法律法规的规定以及《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或《基金合同》）编写。

本招募说明书阐述了建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由建信基金管理有限责任公司负责解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

《基金合同》	《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》及其任何有效的修订和补充
中国	中华人民共和国(仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金或本基金	依据《基金合同》所募集的建信双利策略主题分级股票型证券投资基金
招募说明书	指《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
托管协议	基金管理人与基金托管人签订的《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
发售公告	《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金份额发售公告》
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
《基金合同》当事人	受《基金合同》约束，根据《基金合同》享授权

	利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资人	个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
基金份额持有人	指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
基金销售业务	指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
销售机构	指直销机构和代销机构
直销机构	指建信基金管理有限责任公司
代销机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构
基金销售网点	指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点
注册登记业务	指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金

	份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
注册登记系统	中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统
证券登记结算系统	中国证券登记结算有限责任公司证券登记结算系统
基金账户	指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
交易账户	指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户
基金合同生效日	指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
基金合同终止日	指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
基金募集期	指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月
存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限
基金份额结构	本基金的基金份额包括三种：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额（简称“建信双利基金份额”）、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额（简称“建



信稳健份额”）与建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额（简称“建信进取份额”）。其中，建信稳健份额、建信进取份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变

建信双利基金份额	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额
建信稳健份额	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额
建信进取份额	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额
场内份额的分拆	指场内持有人所持有的建信双利基金份额按照 4:6 的比例分拆成预期收益与风险不同的两类基金份额，即建信稳健份额与建信进取份额的行为
场内份额的合并	指场内持有人所持有的建信稳健份额与建信进取份额按照 4:6 的比例合并成建信双利基金份额的行为
工作日	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
T 日	指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
开放日	指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
交易时间	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
发售	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
认购	指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
申购	指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募

	说明书的规定申请购买建信双利基金份额的行为
赎回	指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将建信双利基金份额兑换为现金的行为
上市交易	指基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖建信稳健份额与建信进取份额的行为
场外	通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、建信双利基金份额申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、建信双利基金份额申购和赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回
场内	指通过深圳证券交易所交易系统内的会员单位进行基金份额认购、建信双利基金份额申购和赎回以及建信稳健份额与建信进取份额上市交易的场所
基金转换	指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
转托管	指基金份额持有人将其基金账户内的建信双利基金份额从一个交易帐户托管转移到另一交易帐户的行为
系统内转托管	投资者将其持有的建信双利基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为

跨系统转托管	投资者将其持有的建信双利基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为
定期定额投资计划	指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
巨额赎回	指本基金单个开放日，建信双利基金份额的净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额（包括建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额）的 10%
元	指人民币元
基金收益	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
基金资产总值	指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
不可抗力	指基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律

法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易、公众通讯设备或互联网故障

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

成立日期：2005年9月19日

法定代表人：江先周

联系人：路彩营

电话：010-66228888

注册资本：人民币2亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下：

股东名称	股权比例
中国建设银行股份有限公司	65%
美国信安金融服务公司	25%
中国华电集团资本控股有限公司	10%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不得以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由5名监事组成，其中包括2名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

公司日常经营由总经理负责。公司根据经营运作需要设置综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部十五个职能部门以及深圳分公司、成都分公司、北京分公司和上海分公司。此外，公司还设有投资决策委员会和风险管理委员会。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

江先周先生，董事长。1982年毕业于东北财经大学，获经济学学士学位。1986年获财政部财政科学研究所经济学硕士学位。1993年获英国 Heriot-Watt 大学商学院国际银行金融学硕士学位。历任中国建设银行行长办公室副处长，中国建设银行国际业务部处长，中国建设银行行长办公室副主任，中国建设银行国际业务部副总经理，中国建设银行基金托管部总经理，中国建设银行基金托管部总经理兼机构业务部总经理。

孙志晨先生，董事。1985年获东北财经大学经济学学士学位，2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长，中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长，中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。

马梅琴女士，董事，现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1984年获中央财政金融学院学士学位。历任中国建设银行筹资储蓄部证券处副处长、中国建设银行筹资储蓄部外币储蓄处处长、中国建设银行零售业务部自动服务处处长、中国建设银行个人银行业务部证券业务处处长、中国建设银行个人金融业务部二级个人客户经理兼证券处高级经理、中国建设银行个人金融业务部二级个人客户经理、中国建设银行个人金融业务部副总经理。

俞斌先生，董事，现任中国建设银行财务会计部总经理助理。1992年获南京大学计算数学专业硕士学位。历任中国建设银行江苏分行泰州分行行长助理、副行长，中国建设银行财务会计部处长。

袁时奋先生，董事，现任信安国际有限公司大中华区首席营运官。1981年毕业于美国阿而比学院。历任香港汇丰银行投资银行部副经理，加拿大丰业

银行资本市场部高级经理，香港铁路公司库务部助理司库，香港置地集团库务部司库，香港赛马会副集团司库，信安国际有限公司大中华区首席营运官。

殷红军先生，董事，现任中国华电集团资本控股有限公司副总经理。1998年毕业于首都经济贸易大学数量经济学专业，获硕士学位。历任中国电力财务有限公司债券基金部项目经理、华电集团财务有限公司投资咨询部副经理（主持工作）、中国华电集团公司改制重组办公室副处长、体制改革处处长、政策与法律事务部政策研究处处长。

顾建国先生，独立董事，现任中国信达资产管理股份有限公司总裁助理。1984年获浙江工业大学管理工程学学士学位，1991年获浙江大学经济系宏观经济专业硕士学位，1994年获财政部财科所研究生部财务学博士学位。历任中国建设银行信托投资公司总裁助理兼财会部经理、中国建设银行会计部副总经理、香港华建国际集团公司总经理。

关启昌先生，独立董事，现任 MORRISON & Company Limited 总裁。1970年获新加坡大学会计学（荣誉）学士学位。并于1992年修完斯坦福大学行政人员课程。历任 Accountant General's Office, Singapore Government 会计师、Turquand Young, Chartered Accountants Hong Kong 核数师、Irish, Young & Outhwaite 核数师、Bechwith Kwan & Company, Chartered Accountants Australia and Hong Kong 合伙人、美林证券总裁、协和集团董事兼总经理、Morrison & Co., LTD 总裁。

沈四宝先生，独立董事，现任对外经贸大学法学院院长。1981年获北京大学法律系国际经济法硕士学位。历任北京大学助教、对外经济贸易大学法学院院长。

## 2、监事会成员

罗中涛女士，监事会主席。1977年毕业于天津南开大学政治经济学专业。历任国家统计局干部、副处长，中国建设银行投资调查部副处长，信贷部副处长、处长，委托代理部处长，中国建设银行基金托管部副总经理，中国建设银行投资托管服务部总经理。

谭旭耀先生，监事，现任现任信安信托（亚洲）有限公司和信安保险（香港）有限公司财务及精算总监，负责信安香港会计、精算及财务管理、产品设计及报价、风险管理等。

唐湘晖女士，监事，现任中国华电集团资本控股有限公司金融管理部经理。1993年获北京物资学院会计学学士，2007年获得清华-麦考瑞大学应用金融硕士。历任中电联电力财会与经济发展研究中心，原电力工业部经济调节司，国家电力公司财务与资产管理部，中国华电集团公司财务与资产管理部，中国华电集团公司结算中心，中国华电集团公司金融管理部副处长，中国华电集团资本控股（财务）公司监审部经理。

翟峰先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部总监。1988年获得安徽省安庆师范学院文学学士学位，1990年获得上海复旦大学国际经济法专业法学学士学位。历任中国日报评论部记者，秘鲁首钢铁矿股份有限公司内部审计部副主任，中国信达信托投资有限公司（原名为中国建设银行信托投资公司）证券发行部副总经理，宏源证券股份有限公司投资银行总部副总经理，上海永嘉投资管理有限公司执行董事、副总经理。

吴洁女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司风险管理部总监。1992年毕业于南开大学金融系，1995年毕业于中国人民银行金融研究所研究生部。历任中国建设银行国际业务部外汇资金处主任科员、中国建设银行资金部交易风险管理处副处长、中国建设银行资金部交易风险管理处、综合处高级副经理（主持工作）。

### 3、公司高管人员

孙志晨先生，总经理（简历请参见董事会成员）。

何斌先生，副总经理。1992年获东北财经大学计划统计系学士学位。先后就职于北京市财政局、北京京都会计师事务所、中国证券监督管理委员会基金监管部，历任国泰基金管理公司副总经理、建信基金管理有限责任公司督察长。

张延明先生，副总经理。1993年获中国人民大学投资经济系学士学位，1997年获中国人民大学投资经济系硕士学位。先后供职于深圳市建设集团、中国建设银行，历任中国建设银行信贷管理部主任科员、中国建设银行行长办公室主任科员、副处长、处长。2006年11月加入建信基金管理有限责任公司，任总经理助理；2008年6月起任建信基金管理有限责任公司副总经理。

王新艳女士，副总经理。注册金融分析师（CFA），中国人民银行研究生部硕士。1998年10月加入长盛基金管理公司，历任研究员、基金经理助理，



2002年11月2日至2004年5月22日担任长盛成长价值股票型证券投资基金的基金经理。2004年6月加入景顺长城基金管理公司，历任基金经理、投资副总监、投资总监等职，2005年3月16日至2009年3月17日任景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）的基金经理，2007年6月18日至2009年3月17日任景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2009年3月加入建信基金管理有限责任公司，任总经理助理，2010年5月起任副总经理。2009年12月17日至2011年2月1日任建信恒久价值股票型证券投资基金的基金经理，2010年4月27日至今任建信核心精选股票型证券投资基金的基金经理。2010年11月16日至今任建信内生动力股票型证券投资基金基金经理。

#### 4、督察长

路彩营女士，督察长。1979年毕业于河北大学经济系计划统计专业。历任中国建设银行副主任科员、主任科员、副处长、处长，华夏证券部门副总经理，宝盈基金管理公司首席顾问（公司副总经理级），建信基金管理有限责任公司监事长。

#### 5、本基金拟任基金经理

万志勇先生，硕士，研究部执行总监兼投资管理部副总监。曾就职于西安创新互联网孵化器有限公司、北方证券有限责任公司、大成基金管理有限公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司（原巨田基金管理有限公司）、银华基金管理有限公司。2008年10月21日至2009年11月10日任银华领先策略基金经理，2009年5月26日至2010年6月17日任银华和谐主题基金基金经理。2010年7月加入建信基金管理有限责任公司，2010年11月起任研究部执行总监。2010年11月17日起任建信内生动力股票型证券投资基金基金经理；2011年5月6日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理；2011年7月11日起任建信优势动力股票型证券投资基金基金经理。

马志强先生，博士。曾就职于东北证券公司、北京高汇投资管理有限公司、北京蓝巢投资有限公司，2004年11月起就职于天弘基金管理公司，2008年12月2日至2011年3月23日任天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。2011年3月加入本公司，2011年8月2日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理。

#### 6、投资决策委员会成员

孙志晨先生，总经理。

王新艳女士，副总经理。

梁洪昀先生，投资管理部执行总监。

万志勇先生，研究部执行总监兼投资管理部副总监。

钟敬棣先生，投资管理部副总监。

姚锦女士，研究部首席策略分析师。

**7、上述人员之间均不存在近亲属关系。**

### **（三）基金管理人的职责**

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告建信双利基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的份额参考净值，确定建信双利基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

### **（四）基金管理人承诺**

- 1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规行为的发生；
- 2、基金管理人承诺防止以下禁止性行为的发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

### 3、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

## (五) 基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

- (1) 全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。
- (2) 独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。
- (3) 相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。
- (4) 有效性原则。公司的内部风险控制工作必须从实际出发，主要通过对工作流的控制，进而实现对各项经营风险的控制。
- (5) 防火墙原则。公司的投资管理、基金运作、计算机技术系统等相关部门，在物理上和制度上适当隔离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，制定严格的批准程序和监督处罚措施。
- (6) 适时性原则。公司内部风险控制制度的制定，应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

## 2、内部控制的主要内容

### （1）控制环境

公司董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。本公司在董事会下设立了审计与风险控制委员会，负责对公司在经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估，对公司监察稽核制度的有效性进行评价，监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评价公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和运行的会计标准。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会，就基金投资等发表专业意见及建议。另外，在公司高级管理层下设立了风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行研究，制定相应的控制制度，并实行相关的风险控制措施。

此外，公司设有督察长，全权负责公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

### （2）风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

### （3）操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

#### （4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

#### （5）监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，履行监督、稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的相关风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期不定期出具监察稽核报告。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确。

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：215.77亿元

法定代表人：傅育宁

行长：马蔚华

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

#### 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截止2011年6月30日，招商银行总资产2.643万亿元人民币，核心资本充足率7.81%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务支持室、产品管理室、运营室、监察稽核室4个职能处室，现有员工52人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；

2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可，被境内外权威媒体评为“中国最佳托管专业银行”“中国资产托管市场创新客户满意首选品牌”6S资产托管综合业务平台荣获“深圳市金融创新奖二等奖第一名”。

经过八年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2010年，招商银行实现托管利润8.11亿元，托管费收入3.21亿元，托管资产突破3200亿元，托管日均存款突破300亿元，托管产品数量、托管资产规模和托管费收入稳居中小托管银行第一，基金托管新增规模居行业首位，内部控制连续四年通过SAS70国际认证。

## （二）主要人员情况

傅育宁先生，招商银行董事长和非执行董事，英国布鲁诺尔大学博士学位。1999年3月开始担任本公司董事。2010年8月起任招商局集团有限公司董事长。兼任招商局国际有限公司（香港联合交易所上市公司）主席，利和经销集团有限公司（香港联合交易所上市公司）及信和置业有限公司（香港联合交易所上市公司）独立非执行董事，香港港口发展局董事，香港证券及期货事务监察委员会成员等；中国南山开发（集团）股份有限公司董事长，招商局能源运

输股份有限公司(上海证券交易所上市公司)董事长,及中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司(深圳证券交易所上市公司)董事长,及新加坡上市公司嘉德置地有限公司独立非执行董事。

马蔚华先生,招商银行执行董事、行长兼首席执行官,1999年1月加入本公司。经济学博士学位,高级经济师。第十一届全国政协委员。1999年1月起任招商银行股份有限公司行长兼首席执行官。分别自1999年9月、2003年9月、2007年11月及2008年10月起兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长及招商基金管理有限公司董事长及永隆银行有限公司董事长,并自2002年7月起担任招商局集团公司董事。同时担任中国国际商会副主席、中国企业家协会执行副会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事、深圳市综研软科学发展基金会理事长和北京大学、清华大学等多所高校兼职教授等职。

唐志宏先生,招商银行副行长,吉林大学本科毕业,高级经济师。1995年5月加入本公司,历任沈阳分行副行长,深圳管理部副主任,兰州分行行长,上海分行行长,深圳管理部主任,总行行长助理,2006年4月起担任本公司副行长。同时担任招商信诺人寿保险公司及中国银联股份有限公司董事。

吴晓辉先生,招商银行资产托管部总经理,大学本科,高级经济师。1993年10月进入招商银行工作;历任招商银行总行计划资金部副总经理,总行资金交易部总经理,招银国际金融有限公司总裁;招商银行济南分行党委书记、行长,2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

胡家伟先生,大学本科学历,现任招商银行资产托管部副总经理。30多年银行业务及管理工作经历,已获得基金从业资格。历任招商银行总行国际业务部副总经理、招商银行蛇口支行副行长、招商银行总行单证中心主任。曾任中国银行湖北省分行国际结算处副科长、副处长、中国银行十堰分行副行长、香港南洋商业银行押汇部高级经理、香港中银集团港澳管理处业务部高级经理等职务。

### （三）基金托管业务经营情况

截至2011年10月31日,招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金(含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招



商安泰债券投资基金), 招商现金增值证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证央企 50 交易型开放式指数基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴业合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)、中银价值精选灵活配置混合型基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级基金、诺安保本混合证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券基金、中银上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金 (QDII-LOF) 共 40 只开放式基金及其它托管资产, 托管资产为 4430.36 亿元人民币。

#### (四) 托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则, 自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念; 形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制, 防范和化解经营风险, 确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整; 建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患, 保证业务稳健运行的风险控制制度, 确保托管业务信息真实、准确、完整、及时; 确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

##### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行行长层面对风险进行预防和控制。招商银行实行董事会领导下的行长负责制，重大事项的决策经行长办公会讨论决定，行长室下设风险控制委员会、内部控制状况评审委员会、稽核监督管理委员会、信息规划委员会等机构。

二级风险防范是总行资产托管部在业务室、专业岗位设置时，必须遵循内部控制制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

总行资产托管部内设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督。

三级风险防范是各业务室对自身业务风险进行自我防范和控制。业务室根据法律法规、监管规定、业务规则及本部门具体情况制定工作流程及风险控制措施。

### 3、内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

（2）审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

（4）有效性原则。内部控制应当符合国家法律法规和监管机关的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行内部控制制度不能存在任何例外，部门任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力。

（5）适时性原则。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

（6）防火墙原则。核算、清算、稽核监察等相关部门，应当在制度上和

人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

#### 4、内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行托管业务内控管理办法》和《招商银行证券投资基金托管业务操作规程》等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险

（3）业务信息风险控制。招商银行资产托管部通过数据加密传输、业务信息启动异地自动备份功能、业务信息磁带备份并由专人签收保存等措施保证业务信息及数据传递的安全性。业务信息不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室审批，并做好调用登记。

（4）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务运作过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

（5）信息技术系统风险控制。招商银行资产托管部对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房空间隔离并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

（6）人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

## （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有

关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、场外发售机构

##### （1）直销机构

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：江先周

联系人：孙桂东

电话：010-66228800

##### （2）场外代销机构

###### （1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼(长安兴融中心)

法定代表人：郭树清

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

###### （2）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

###### （3）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

客服电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(4) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

网址：[www.95559.com.cn](http://www.95559.com.cn)

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

客户服务电话：95555

传真：0755-83195049

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(6) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

公司网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(7) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

客服电话：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

(8) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

公司网站：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(9) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

公司网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(10) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：万建华

客服电话：400-8888-666

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(11) 中信证券股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人：王东明

客服电话：95558

网址：[www.citics.com](http://www.citics.com)

(12) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市市南区东海西路 28 号

法定代表人：张智河

客服电话：0532-96577

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

(13) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

客服电话：10108998

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(14) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

客户服务热线：95565、4008888111

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(15) 中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯商务楼 A 座

法定代表人：刘军

客服电话：0571-96598

网址：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

(16) 长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

客服电话：0755-82288968

网址：[www.cc168.com.cn](http://www.cc168.com.cn)

(17) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

客户服务电话：400-8888-001，（021）962503

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(18) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

客户服务电话：4008-888-8888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(19) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务电话：4008-888-999

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(20) 华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道 4011 号香港中旅大厦 25、24 楼

法定代表人：马昭明

客户服务电话：95513



公司网址：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

(21) 中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(22) 华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户咨询电话：025-84579897

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(23) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

客户服务热线：95538

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(24) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市人民大街 138-1 号

法定代表人：矫正中

客户服务电话：0431-96688、0431-85096733

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(25) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：张志军

客户服务电话：4006515988

网址：[www.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

(26) 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：王志伟

客户服务电话：020-95575

网址：www.gf.com.cn

(27) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

法定代表人：黄金琳

客服热线：0591-96326

网址：www.gfhfzq.com.cn

(28) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

(29) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路99号

法定代表人：兰荣

客户服务电话：4008888123

网址：www.xyzq.com.cn

(30) 财富证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路2段80号顺天国际财富中心26层

法定代表人：周晖

客户服务电话：0731-4403340

网址：www.cfzq.com

(31) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

客服热线：4008866338

网址：stock.pingan.com

(32) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼

法定代表人：朱科敏

客服热线：4008888588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(33) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(34) 中国建银投资证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心  
48-50 层

法定代表人：杨小阳

开放式基金咨询电话：4006008008

网址：[www.cjis.cn](http://www.cjis.cn)

(35) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单  
元

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 20 层

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：0755-82825555

网址：[www.axzq.com.cn](http://www.axzq.com.cn)

(36) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路 2 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

客服电话：4008-000-562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(37) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

客服电话：021-962518

网址：www.962518.com

（38）国元证券股份有限公司

注册地址：合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

客户服务热线：400-8888-777

网址：www.gyzq.com.cn

（39）申银万国证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

客服电话：95523 或 400-889-5523

网址：www.sywg.com

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

## 2、场内发售机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

### （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街27 号投资广场23 层

法定代表人：金颖

办公地址：北京西城区金融大街27 号投资广场23 层

联系电话：0755-25938095

传真：0755-25987538

联系人：任瑞新

### （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层

负责人：王丽

联系人：徐建军

电话：010—66575888

传真：010—65232181

经办律师：徐建军、李晓明

#### （四）审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：张鸿

经办会计师：薛竞、张鸿

## 六、基金份额分级

### （一）基金份额结构

本基金的基金份额包括三种：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额（简称“建信双利基金份额”）、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额（简称“建信稳健份额”）与建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额（简称“建信进取份额”）。其中，建信稳健份额、建信进取份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变。

### （二）基金的基本运作概要

1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为建信双利基金份额；场内认购的全部份额将按 4:6 的比率确认为建信稳健份额与建信进取份额；

2、本基金合同生效后，建信双利基金份额只接受场外与场内申购和赎回，不上市交易；

3、投资者可选择将其登记在场内的建信双利基金份额按 4:6 的比例分拆成建信稳健份额和建信进取份额；

4、建信稳健份额、建信进取份额只上市交易，不接受申购和赎回；

5、本基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定办理建信双利基金份额与建信稳健份额、建信进取份额之间的份额配对转换业务；

6、本基金合同生效后，基金管理人按照基金合同的约定在基金份额折算日对所有基金份额进行折算。折算后基金运作方式及建信稳健与建信进取份额配比不变。

### （三）建信稳健、建信进取份额概要

#### 1、 存续期限

自基金合同生效之日起存续。

#### 2、 基金份额配比

建信稳健份额与建信进取份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比率不变。

### 3、 建信稳健、建信进取份额净值计算原则

本基金对建信稳健、建信进取份额风险和收益特性的安排不同，其净值计算遵循以下原则：

（1）建信稳健份额约定年基准收益率为“一年期同期银行定期存款利率+3.5%”，一年期同期银行定期存款利率以当年 1 月 1 日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。年基准收益均以 1.00 元为基准进行计算；

建信稳健份额的约定年基准收益率除以 365 得到建信稳健份额的约定日收益率。

（2）本基金每个工作日对建信稳健份额和建信进取份额进行基金份额参考净值计算。在进行建信稳健份额和建信进取份额各自的基金份额参考净值计算时，本基金净资产优先确保建信稳健份额的本金及建信稳健份额累计约定日收益，之后的剩余净资产计为建信进取份额的净资产。建信稳健份额累计约定日收益按依据建信稳健份额约定年基准收益率计算的每日单利和截至计算日建信稳健份额应计收益的天数确定；

（3）每 10 份建信双利基金份额所代表的 4 份建信稳健份额和 6 份建信进取份额分别计入建信稳健份额总额和建信进取份额总额进行净值计算，并将分别按分离后的建信稳健份额和建信进取份额的份额数享有获得份额折算的权利，每 10 份建信双利基金份额所代表的资产净值等于 4 份建信稳健份额和 6 份建信进取份额的资产净值之和；

（4）若在本基金存续的完整会计年度内未发生《基金合同》约定的份额折算事项，建信稳健份额应计收益的天数按该会计年度年初至计算日的实际天数计算；在本基金的基金合同生效日所在会计年度，或者在某一会计年度内本基金依据《基金合同》之规定进行不定期份额折算的，建信稳健份额在净值计算日应计收益的天数应按照自基金合同生效日、或者最近一次该会计年度内份额折算日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证建信稳健份额的基金份额持有人的约定收益。

#### （四）本基金基金份额净值的计算

本基金作为分级基金，按照建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健

份额与建信进取份额的基金份额参考净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日建信双利基金份额的基金份额净值和建信稳健份额、建信进取份额的基金份额参考净值：

### 1、建信双利基金份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日建信双利基金份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金，T 日本基金基金份额的总数为建信稳健份额、建信进取份额和建信双利基金份额的份额数之和。

### 2、建信稳健份额和建信进取份额 T 日的基金份额参考净值计算

$$NAV(A)_T = 1 + \frac{(R + 3.5\%) \times t}{365}$$

$$NAV(B)_T = \frac{[NAV_t - 0.4 \times NAV(A)_T]}{0.6}$$

其中：

$NAV(A)_T$  为 T 日建信稳健份额的参考净值；

$NAV(B)_T$  为 T 日建信进取份额的参考净值；

$t = \min\{\text{自年初至 T 日的天数, 自基金合同生效日至 T 日的天数, 自最近一次会计年度内份额不定期折算日至 T 日的天数}\}$ ；

R 为一年期同期银行定期存款利率。

建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### 3、示例

假设自基金合同生效日至 T 日本基金运作了 100 天，建信双利基金份额的份额净值分别为 1.200 元、0.950 元、0.526 元，当年 1 月 1 日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为 3.00%，其间本基金未进行不定期



折算。

(1) 当  $NAV_T = 1.200$  元时

根据基金份额净值计算规则，建信稳健份额和建信进取份额的基金份额参考净值为：

$$NAV(A)_T = 1 + \frac{(3.0\% + 3.5\%) \times 100}{365} = 1.018 \text{元}$$

$$NAV(B)_T = \frac{1.200 - 0.4 \times 1.018}{0.6} = 1.321 \text{元}$$

(2) 当  $NAV_T = 0.950$  元时

根据基金份额净值计算规则，建信稳健份额和建信进取份额的基金份额参考净值为：

$$NAV(A)_T = 1 + \frac{(3.0\% + 3.5\%) \times 100}{365} = 1.018 \text{元}$$

$$NAV(B)_T = \frac{0.950 - 0.4 \times 1.018}{0.6} = 0.905 \text{元}$$

(3) 当  $NAV_T = 0.526$  元时

根据基金份额净值计算规则，建信稳健份额和建信进取份额的基金份额参考净值为：

$$NAV(A)_T = 1 + \frac{(3.0\% + 3.5\%) \times 100}{365} = 1.018 \text{元}$$

$$NAV(B)_T = \frac{0.526 - 0.4 \times 1.018}{0.6} = 0.198 \text{元}$$

由于建信进取份额的基金份额参考净值小于 0.200 元，触发了不定期折算机制，基金管理人将根据基金合同约定对本基金所有份额进行折算，所有的基金份额净值调整到 1.000 元。

## 七、基金的募集

### （一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。

本基金募集申请已经中国证监会 2011 年 3 月 10 日证监许可[2011]355 号文核准。

### （二）基金类型

股票型。

### （三）基金的运作方式

契约型开放式。

### （四）基金存续期限

基金存续期限为不定期。

### （五）基金的面值

本基金每份基金份额的初始发售面值为人民币 1.00 元。

### （六）募集方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售。

### （七）募集期限

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月。

本基金自 2011 年 4 月 1 日至 2011 年 4 月 29 日进行发售。如果在此期间届满时未达到本招募说明书第八章第（一）条规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。本基金合同已于 2011 年 5 月 6 日生效。

## （八）募集对象

指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

## （九）募集场所

本基金通过场外、场内两种方式公开发售。本基金在场外通过基金管理人的直销机构和基金销售代理机构的代销网点，在场内通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位向社会公开募集。具体募集场所见基金份额发售公告。基金管理人可以根据情况增加其他代销机构，并另行公告。

## （十）募集目标

本基金募集规模不设上限。最低募集规模为 2 亿份。

## （十一）认购安排

1、认购时间：本基金向个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者同时发售，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

2、投资者认购应提交的文件和办理的手续：详见基金份额发售公告及销售机构发布的相关公告。

3、认购限额：

代销网点每个基金账户每次认购金额不得低于 1000 元人民币，代销机构另有规定的，从其规定。直销机构每个基金账户首次认购金额不得低于 5 万元人民币，已在直销机构有认购本基金记录的投资者不受上述认购最低金额的限制，单笔追加认购最低金额为 1000 元人民币。当日的认购申请在销售机构规定的时间之后不得撤销。

在具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位的单笔最低认购份额为 1000 份，超过 1000 份的须是 1000 份的整数倍，且每笔认购最大不得超过 99,999,000 份。

## （十二）认购费用

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减，场外认购费率结构如下表所示：

认购金额（M）	认购费率
M<100 万元	1.2%
100 万元≤M<500 万元	0.8%
M≥500 万元	1000 元/笔

本基金的场内认购费率由销售机构参照场外认购费率执行。

本基金认购费由认购人承担，可用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

## （十三）认购份数的计算

1、基金场外认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率});$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额};$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额初始发售面值}。$$

场外认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资人投资 100,000 元认购本基金，对应费率为 1.2%，假设该笔认购产生利息 50 元，则其可得到的建信双利基金份额数为：

$$\text{净认购金额} = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 100,000 - 98,814.23 = 1185.77 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (98,814.23 + 50) / 1.00 = 98,864.23 \text{ 份}$$

2、基金场内认购采用份额认购的方式。计算公式为：

$$\text{认购金额} = \text{净认购金额} + \text{认购费用};$$

$$\text{认购费用} = \text{挂牌价格} \times \text{认购份额} \times \text{认购费率};$$

$$\text{净认购金额} = \text{挂牌价格} \times \text{认购份额};$$

利息折算份额=利息/挂牌价格；

经确认的建信稳健份额=（认购份额+利息折算份额）×0.4；

经确认的建信进取份额=（认购份额+利息折算份额）×0.6；

场内认购金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入。经确认的建信稳健份额、建信进取份额保留至整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

例：某投资人投资认购 100,000 份基金份额，若会员单位设定的认购费率为 1.2%，假设该笔认购产生利息 50 元，基金份额挂牌价格为 1 元，则其可得到的建信稳健份额与建信进取份额数为：

认购金额=1×（1+1.2%）×100,000=101,200 元

认购费用=1×100,000×1.2%=1,200 元

净认购金额=1×100,000=100,000 元

利息折算份额=50/1=50 份

经确认的建信稳健份额=（100,000+50）×0.4=40,020 份

经确认的建信进取份额=（100,000+50）×0.6=60,030 份

## （十四）认购的方法与确认

### 1、认购方法

投资者认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续，由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

### 2、认购确认

基金销售网点受理投资者的申请并不表示对该申请已经成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册登记机构的确认登记为准。投资者可在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

## （十五）募集资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息，在基金合同生效后折算为基金份额归基金份额持有人所有，不收取认购费用。利息以注册登记机构的记录为准。

## （十六）募集结果

截至 2011 年 4 月 29 日，基金募集工作已经顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为人民币 2,973,543,800.59 元，本次募集所有认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 964,448.38 元。本次募集有效认购户数为 45,605 户，按照每份基金份额初始面值人民币 1.00 元计算，募集期募集资金及利息结转的基金份额共计 2,974,508,248.97 份，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

## 八、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

1、基金募集期限届满，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

2、基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。本基金合同已于 2011 年 5 月 6 日生效。

3、本基金基金合同生效前，投资者的认购款项只能存入专门账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金基金合同生效后折成基金份额，归基金份额持有人所有。利息转成基金份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### （二）基金募集失败时的处理方式

1、基金募集期限届满，未达到基金合同生效条件，则基金募集失败。

2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

## 九、建信稳健、建信进取的上市与交易

### （一）上市交易的基金份额

本基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请建信稳健、建信进取上市交易。建信稳健与建信进取两类基金份额同时申请上市与交易，交易代码不同；投资者可以在二级市场单独交易建信稳健或者建信进取；基金份额交易按照深圳证券交易所交易规则及相关规定执行。

### （二）上市交易的地点

深圳证券交易所。

建信稳健、建信进取份额上市后，登记在中国证券登记结算有限公司场内证券登记结算系统中的建信稳健和建信进取份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在场外中国证券登记结算有限公司注册登记系统中的建信双利基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记结算系统，并且发起份额分离请求，建信双利基金份额成功分离为建信稳健、建信进取后，方可上市交易。

### （三）上市交易的时间

建信稳健、建信进取于本基金合同生效后三个月内开始在深圳证券交易所上市交易；在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

建信稳健、建信进取已于 2011 年 6 月 8 日开始在深圳证券交易所上市交易。

### （四）上市交易的规则

- 1、建信稳健份额、建信进取份额上市首日的开盘参考价为前一交易日建信稳健份额、建信进取份额参考净值；
- 2、建信稳健份额、建信进取份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 3、建信稳健份额、建信进取份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；



4、建信稳健份额、建信进取份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；

5、建信稳健份额、建信进取份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

### **（五）上市交易的费用**

建信稳健、建信进取份额上市交易的费用比照上市开放式基金的有关规定办理。

### **（六）上市交易的行情揭示**

建信稳健、建信进取在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示建信稳健、建信进取前一交易日的基金份额参考净值。

### **（七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市**

建信稳健、建信进取的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》及深圳证券交易所的相关规定执行。

### **（八）上市交易的其他规定**

相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 十、基金份额的申购与赎回

基金管理人建信双利基金份额开放申购与赎回业务。建信双利基金份额的申购与赎回包括场内申购与赎回和场外申购与赎回两种方式。

### （一）申购与赎回办理的场所

场内申购与赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位（具体名单见基金份额发售公告及开放申购赎回公告）。

场外申购赎回场所包括基金管理人和基金管理人委托的场外代销机构（具体名单见基金份额发售公告及开放申购赎回公告）。

基金投资者应当在上述销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金销售机构，并予以公告。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

在基金开放日，投资者提出的申购、赎回申请时间应在上海证券交易所与深圳证券交易所当日收市时间（目前为下午3:00）之前，其建信双利基金份额基金份额申购、赎回的价格为当日的价格；如果投资人提出的申购、赎回申请时间在上海证券交易所与深圳证券交易所当日收市时间之后，其建信双利基金份额基金份额申购、赎回的价格为下一开放日的价格。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

#### 2、申购与赎回的开始时间

本基金已于2011年6月8日起开始办理日常申购、赎回业务。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即本基金的申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

4、先进先出原则，即在基金份额持有人赎回基金份额、基金管理人对该基金份额持有人的基金份额进行赎回处理时，认购、申购确认日期在先的基金份额先赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购与赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购建信双利基金份额时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时须持有足够的建信双利基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

#### 2、申购与赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金销售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

#### 3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者资金账户。

投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人资金账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

### （五）申购与赎回的数额限制

1、本基金代销网点每个基金账户单笔申购最低金额为1000元人民币，代销机构另有规定的，从其规定；直销机构每个基金账户首次最低申购金额为5万元人民币，已在直销机构有申购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，单笔申购最低金额为1000元人民币；

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于1000份建信双利基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足100份的，余额部分建信双利基金份额在赎回时需同时全部赎回。

3、基金管理人可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前2个工作日至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

### （六）申购费率与赎回费率

#### 1、申购费率

本基金对申购设置级差费率，场内申购和场外申购执行统一收费标准。申购费率随申购金额的增加而递减，最高申购费率不超过1.5%：

申购金额（M）	申购费率
M<100 万元	1.5%
100 万元≤M<500 万元	1.0%

M≥500 万元	1000 元/笔
----------	----------

申购费用由申购人承担，不列入基金资产，申购费用用于本基金的市场推广、注册登记和销售。

## 2、赎回费率

场外赎回费率按照持有期限设置级差费率，最小赎回费率为零；场内赎回费率为固定的0.5%。

持有期限（Y）	场外赎回费率	场内赎回费率
持有期<1 年	0.5%	0.5%
1 年≤持有期<2 年	0.25%	
持有期≥2 年	0%	

赎回费用由赎回人承担，赎回费中25%归入基金资产，其余部分作为本基金用于支付注册登记费和其他必要的手续费。（注：1年指365天）

3、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体及基金管理人网站公告。

## （七）申购份数与赎回金额的计算方式

### 1、场外申购份额的计算

申购建信双利基金份额的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者投资5万元场外申购建信双利基金份额，假设申购当日建

信双利基金份额净值为1.05元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50000 / (1 + 1.5\%) = 49261.08 \text{元}$$

$$\text{申购费用} = 50000 - 49261.08 = 738.92 \text{元}$$

$$\text{申购份额} = 49261.08 / 1.05 = 46915.31 \text{份}$$

即：投资者投资5万元场外申购建信双利基金份额，假设申购当日建信双利基金份额净值为1.05元，则其可得到46915.31份建信双利基金份额。

## 2、场内申购份额的计算

申购建信双利基金份额的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

场内申购份额计算结果保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例：某投资者通过场内投资10000元申购建信双利基金份额，对应的申购费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.025元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

$$\text{净申购金额} = 10000 / (1 + 1.5\%) = 9852.22 \text{元}$$

$$\text{申购手续费} = 10000 - 9852.22 = 147.78 \text{元}$$

$$\text{申购份额} = 9852.22 / 1.025 = 9611.92 \text{份}$$

因场内申购份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为9611份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资者。具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 9611 \times 1.025 = 9851.28 \text{元}$$

$$\text{退款金额} = 10000 - 9851.28 - 147.78 = 0.94 \text{元}$$

即：投资者投资10000元从场内申购建信双利基金份额，假设申购当日建信双利基金份额净值为1.025元，则其可得到建信双利基金份额9611份，退款0.94元。

## 3、赎回净额的计算

场内赎回和场外赎回计算方法相同。基金份额持有人在赎回建信双利

基金份额时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日建信双利基金份额净值}$$
$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$
$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回净额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者赎回建信双利基金份额 10000 份，赎回适用费率为 0.5%，假设赎回当日建信双利基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.148 = 11480 \text{ 元}$$
$$\text{赎回费用} = 11480 \times 0.5\% = 57.40 \text{ 元}$$
$$\text{净赎回金额} = 11480 - 57.40 = 11422.60 \text{ 元}$$

即：投资者赎回建信双利基金份额 10000 份，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11422.60 元。

#### 4、基金份额净值计算

本基金建信双利基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### （八）申购与赎回的注册登记

1、投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

2、投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

## （九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；
- （2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- （3）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- （4）本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- （5）基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券结算登记系统无法正常运行；
- （6）《基金合同》约定、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；
- （7）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（6）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停申购公告。暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

## （十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

- （1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；
- （2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- （4）基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券



结算登记系统无法正常运行；

(5)《基金合同》约定、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第(3)款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停建信双利基金份额的赎回，基金管理人应及时在至少一家指定媒体及基金管理人网站上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

## (十一) 巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，建信双利基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额（包括建信双利基金份额、建信稳健份额及建信进取份额）的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额（包括建信双利

基金份额、建信稳健份额及建信进取份额)的10%的前提下,对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请,应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例,确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额;投资者未能赎回部分,除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外,延迟至下一个开放日办理,赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权,并以此类推,直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 巨额赎回的公告:当发生巨额赎回并顺延赎回时,基金管理人应在3个工作日内通过指定媒体及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告,并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人,并说明有关处理方法。

连续2个或2个以上开放日发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过20个工作日,并应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

## (十二) 重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天,基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登建信双利基金份额重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的建信双利基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周,暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登建信双利基金份额重新开放申购或赎回的公告,并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的建信双利基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站连续刊登建信双利基金份额重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公

告最近一个工作日的建信双利基金份额净值。

### （十三）基金的转换

为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金建信双利基金份额和基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

### （十四）基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

#### 1、基金份额的登记

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的建信双利基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购的建信双利基金份额或上市交易买入的建信稳健份额和建信进取份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。登记在证券登记结算系统中的建信稳健份额和建信进取份额只能在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回。登记在证券登记结算系统中的建信双利基金份额可以直接申请场内赎回，登记在注册登记系统中的建信双利基金份额可申请场外赎回。

#### 2、系统内转托管

（1）系统内转托管是指持有人将持有的建信双利基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

（2）建信双利基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有建信双利基金份额的系统内转托管。

（3）建信双利基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位（席位）时，可办理已持有建信双利基金份额的系统内转托管。

（4）募集期内不得办理系统内转托管。

#### 3、跨系统转托管

(1) 跨系统转托管是指持有人将持有的建信双利基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

(2) 本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

(3) 投资者采用基金管理人直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额将不能办理跨系统转托管业务。若网上交易有关规定及业务规则发生变更，基金管理人可为投资者采用直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额办理跨系统转托管时，届时基金管理人将做出调整并及时公告。

### **(十五) 定期定额投资计划**

基金管理人可以为投资者办理建信双利基金份额的定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

### **(十六) 基金的非交易过户**

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料。

对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### **(十七) 基金的冻结与解冻**

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与

解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。  
基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金注册登记机构的相关规定办理。

## 十一、场内份额的配对转换

本基金《基金合同》生效后，在建信稳健份额、建信进取份额的存续期内，本基金份额持有人可办理场内份额配对转换业务。

### （一）场内份额配对转换

1、场内份额的分拆，指场内持有人将其所持有的“建信双利基金份额”按照 4:6 的比例分拆成“建信稳健份额”与“建信进取份额”，即每 10 份“建信双利基金份额”分拆成 4 份“建信稳健份额”与 6 份“建信进取份额”的行为。

2、场内份额的合并，指场内持有人将其所持有的“建信稳健份额”与“建信进取份额”按照 4:6 的比例合并成“建信双利基金份额”，即每 4 份“建信稳健份额”与 6 份“建信进取份额”合并成 10 份“建信双利基金份额”的行为。

3、场外的建信双利基金份额不进行份额配对转换。在场外建信双利基金份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

### （二）业务办理机构

本基金场内份额配对转换业务的办理机构见基金管理人届时发布的相关公告。深圳证券交易所、基金登记结算机构或基金管理人可根据情况变更或增减该业务的办理机构，并予以公告。

### （三）业务办理时间

场内份额配对转换自建信稳健份额、建信进取份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理该业务前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站上予以公告。

### （四）业务办理程序

场内份额配对转换程序遵循深圳证券交易所、基金登记结算机构的最新业务规则，具体见相关业务公告。

## （五）暂停场内份额配对转换的情形

1、深圳证券交易所、基金登记结算机构、业务办理机构因异常情况无法办理该业务的情形。

2、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情况的，基金管理人应在至少一家指定媒体及基金管理人网站就暂停场内份额配对转换业务予以公告。

当恢复场内份额配对转换业务时，基金管理人也将在至少一家指定媒体及基金管理人网站予以公告。

## （六）业务办理费用

具体见相关业务公告。本基金场内份额配对转换业务的办理机构可对该业务的办理酌情按照不高于 0.3% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用，具体见相关业务公告。

## 十二、基金的投资

### （一）投资目标

本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规和监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金为股票型基金，基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0-3%；固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

### （三）投资理念

较高仓位、主题挖掘、个股精选。具体来说，包含以下三方面的内容：

#### 1、较高仓位

本基金的股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，通过减少对股票市场趋势的主观判断，坚持既定且稳定的投资风格和策略，以获取长期较高的资本利得。

#### 2、主题挖掘

本基金建立自上而下的投资主题分析框架，综合运用定量和定性分析方法，通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题。



本基金投资于核心主题企业的股票比例不低于基金股票资产的 80%。

### 3、个股精选

本基金将精选那些受惠于投资主题并具有竞争力的上市公司进行投资。

## （四）投资业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 商业银行活期存款利率。

如果基金所跟踪的目标指数被中证指数有限公司停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更基金的业绩比较基准，并在变更前提前 2 个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

## （五）投资策略

### 1、大类资产配置策略

根据现代投资组合理论，资产配置决策应该基于对大类资产的预期收益率、风险水平及其相关性的判断而制定，本基金将以此为出发点，对于可能影响资产预期收益率、风险水平和相关性的因素进行综合分析和动态跟踪，据此制定基金在股票、债券和货币市场工具等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，并进行定期或不定期调整，以达到控制风险、增加收益的目的。

此外，基金管理人还将关注其他可能影响资产预期收益率与风险水平的因素，观察市场信心指标、行业动量指标等，力争捕捉市场由于低效或失衡而产生的投资机会。

通常情况下，基金管理人会定期根据市场变化，以研究结果为依据对当前资产配置进行评估并作必要调整。在特殊情况下，亦可针对市场突发事件等进行及时调整。本基金资产配置具体调整流程如下：

- （1）计算股票市场估值水平；
- （2）分析宏观经济运行特征，预测未来经济增长率、行业、公司的盈

利增长率，分析债券预期收益率；

(3) 综合比较股票市场估值、债券收益率以及未来公司盈利增长，确定资产组合配置；

(4) 根据资产组合调整规模、市场股票资金供需状况，将对不同调整方案的风险、收益进行模拟，确定最终资产配置方案。

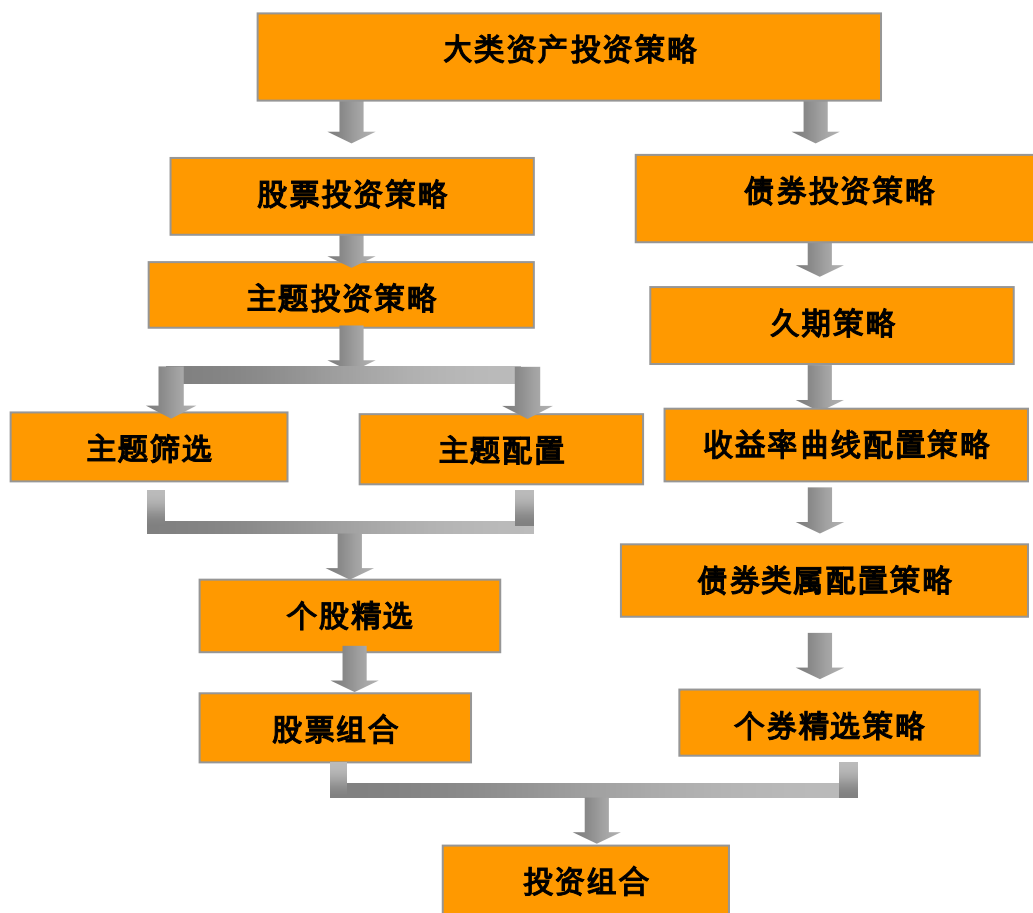


图1 大类资产投资策略

## 2、股票投资组合策略

### (1) 主题筛选策略

本基金将通过自上而下的方式，从社会、文化、科技、国内外宏观经济、国家政策、资本市场发展情况等多个角度出发，在深入研究的基础上，通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题（详见图2）。

按照主题产生的大类原因，本基金将主要关注以下五类主题：政策促进

类主题、模式转化类主题、科技进步类主题、投资工具增加类主题、事件类主题，通过对投资主题的细分，可以帮助本基金更好地把握主题的发展规律，并且有利于本基金对于同类主题投资机会的对比分析。

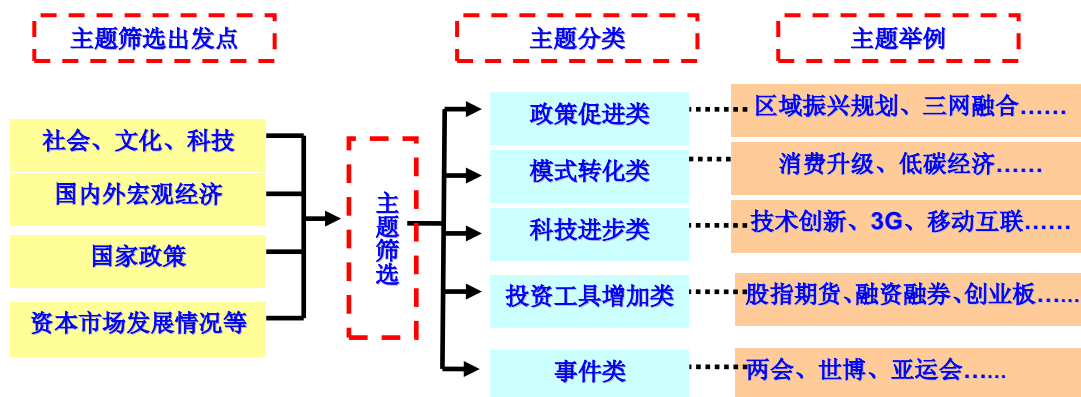


图 2 主题筛选策略

## (2) 主题配置策略

在主题筛选的基础上,本基金将综合考虑主题产生原因、主题景气程度、主题投资可行性、主题估值水平等因素,确定每个主题的配置权重范围,从而进行主题配置(详见图 3)。

分析主题产生的原因以及原因的可持续性是决定主题配置的首要因素。在主题产生的初期,本基金将对其产生的原因进行分析,同时通过分析促进主题发展的各项原因的可持续性、对产生原因相同或者相似的主题进行对比分析,选择出发展前景良好、具有投资价值的主题。

主题的景气程度分析主要包括投资者对主题的关注程度分析、主题的发展阶段分析等方面,随着市场对主题关注程度的变化以及主题发展阶段的变化,本基金将对主题的配置比例进行调整。

主题投资可行性主要考察主题市场容量、流动性、覆盖率等因素,本基金选用流通市值占比、总市值和日均成交金额等作为主题市场投资可行性的参考指标。

主题市场估值是指主题覆盖个股的估值指标均值,本基金将选用市盈率、市净率和市销率等作为市场估值的参考指标。



图3 主题配置策略

### (3) 个股投资策略

在前述主题筛选和主题配置的基础上，本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合（详见图4）。

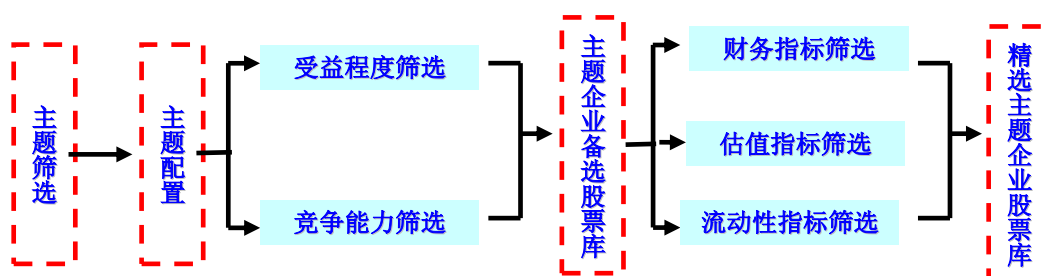


图4 个股投资策略

具体分以下两个层次进行股票挑选：

#### A、备选主题企业股票库投资策略

在确立投资主题及投资主题配置比例之后，本基金将选择受益于投资主题并且具有良好竞争能力的股票进入备选库，具体来说本基金对上市公司受益程度以及竞争能力考核的指标主要有：

##### I、受益程度筛选

主要包括公司盈利模式、公司业绩受主题驱动的程度以及持续性、类似公司受主题驱动程度的比较、公司业绩弹性等。

## II、竞争能力筛选

主要包括包括公司治理结构、管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、是否具有垄断性资源、是否具有行业壁垒、是否有专有技术、特许权、品牌知名度、是否是行业垄断或寡头垄断者等。

### B、精选主题企业股票库投资策略

在主题企业备选股票库的基础上，本基金将通过三类指标的筛选最终确定精选主题企业股票库：

#### I、财务指标筛选

主要包括偿债能力分析指标、营运能力分析指标、盈利能力分析指标、发展能力分析指标四个方面。

#### II、估值指标筛选

主要包括 PE、PB、EV/EBITDA、PS 等指标。

#### III、流动性指标

主要包括流通市值、总市值、日均成交金额、换手率等指标。

## 3、债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：

### (1) 久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

### (2) 收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

### (3) 债券类属配置策略

根据国债、金融债、公司债、可转债、资产支持证券等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被

相对高估的类属债券，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对公司债、可转债、资产支持证券等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和管理，获取超额收益。

#### （4）个券精选策略

个券精选策略指基于对信用质量、期限和流动性等因素的考察，重点关注具有以下特征的债券：较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善、期权价值被低估，或者属于创新品种而价值尚未被市场充分发现的个券。通过深入研究，发掘这些具有较高当期收益率或者较高升值潜力的债券，可为投资者创造超额投资回报。

### 4、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

## （六）投资管理体制及流程

### 1、投资管理体制

本基金管理人建立了包括投资决策委员会、投资管理部、研究部、交易部等部门的完整投资管理体系。

投资决策委员会是负责基金资产运作的最高决策机构，根据基金合同、法律法规以及公司有关规章制度，确定公司所管理基金的投资决策程序、权限设置和投资原则；确定基金的总体投资方案；负责基金资产的风险控制，审批重大投资事项；监督并考核基金经理。投资管理部及基金经理根据投资决策委员会的决策，构建投资组合、并负责组织实施、追踪和调整，以实现基金的投资目标。研究部提供相关的投资策略建议和证券选择建议，并负责构建和维护股票池。交易部根据基金经理的交易指令，进行基金资产的日常交易，对交易情况及时反馈。

### 2、投资流程

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理体制，具体的投资管理流程如图 5 所示。

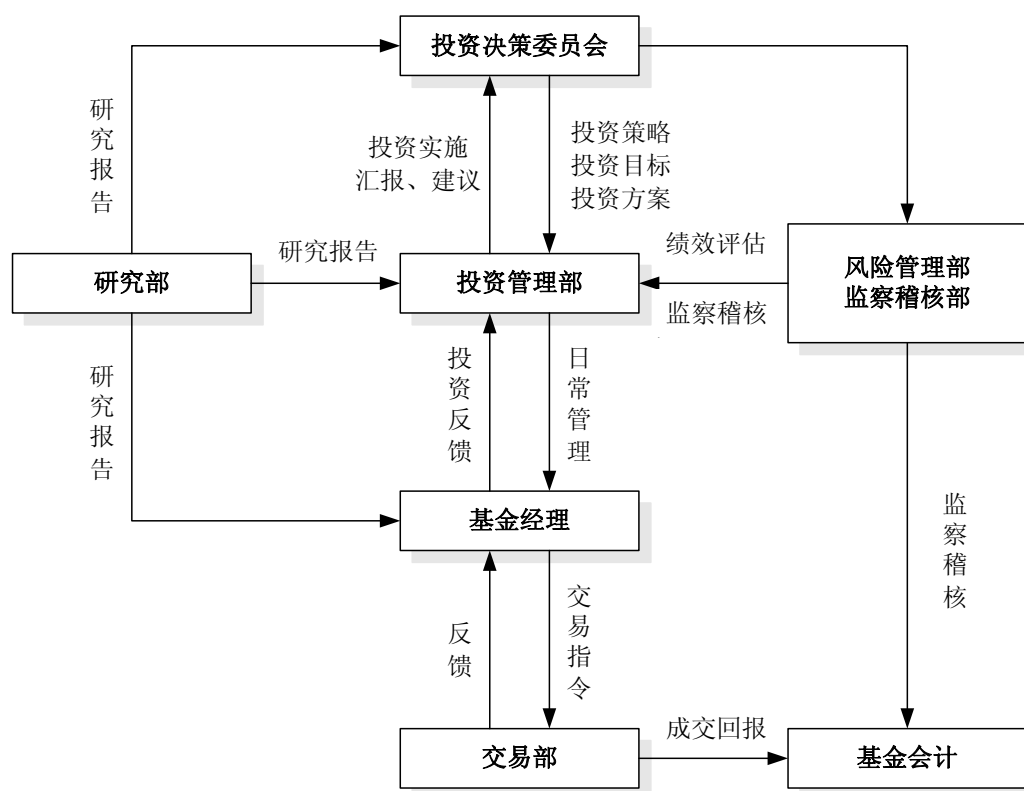


图 5 基金投资管理流程示意图

### (1) 研究分析

研究部及投资管理部广泛地参考和利用公司内、外部的研究成果，走访拟投资公司或其他机构，进行深入细致的调查研究，了解国家宏观经济政策及行业发展状况，挖掘有投资价值的拟投资上市公司，同时，建立相关研究模型。研究部撰写宏观策略报告、行业策略报告和拟投资上市公司投资价值分析等报告，作为投资决策依据之一。

研究部和投资管理部定期或不定期举行投资研究联席会议，讨论宏观经济、行业、拟投资上市公司及相关问题，作为投资决策的重要依据之一。

### (2) 投资决策

投资决策委员会根据基金合同、相关法律法规以及公司有关规章制度确定基金的投资原则以及基金的资产配置比例范围，审批总体投资方案以及重大投资事项。

基金经理根据投资决策委员会确定的投资对象、投资结构、持仓比例范围等总体投资方案，并结合研究人员提供的投资建议、自己的研究与分

析判断、以及基金申购赎回情况和市场整体情况，构建并优化投资组合。对于超出权限范围的投资，按照公司权限审批流程，提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

### **(3) 交易执行**

交易部接受基金经理下达的交易指令。交易部接到指令后，首先应对指令予以审核，然后再具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的，交易部可以暂不执行指令，并即时通知基金经理或相关人员。

交易部应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该项交易的判断和建议，以便基金经理及时调整交易策略。

### **(4) 投资回顾**

绩效评估小组定期对基金绩效进行评估。基金经理定期向投资决策委员会回顾前期投资运作情况，并提出下期的操作思路，作为投资决策委员会决策的参考。

## **(七) 基金的风险收益特征**

本基金属于采用高仓位操作的股票型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。

从本基金所分离的两类基金份额来看，建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额；建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征，其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

## **(八) 投资限制**

### **1、禁止行为**

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；



- (4) 买卖其他基金份额,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券;
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
- (7) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
- (8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## 2、投资组合限制

基金管理人运用基金财产进行证券投资,遵守下列限制:

- (1) 本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%-95%;
- (2) 本基金持有的固定收益类证券和现金占基金资产的比例为 5%—10%;
- (3) 本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;
- (4) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- (5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;
- (6) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的 10%;
- (7) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;
- (8) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;
- (9) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;

- (10) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (12) 本基金持有的债券其信用级别不低于 BBB 级；
- (13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (14) 法律法规及中国证监会规定的其他限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述约定比例的，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

### **（九）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法**

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

## （十）基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告期截至 9 月 30 日止。

### 10.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,568,061,333.03	82.07
	其中：股票	1,568,061,333.03	82.07
2	固定收益投资	48,300,000.00	2.53
	其中：债券	48,300,000.00	2.53
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	288,459,367.92	15.10
6	其他各项资产	5,890,854.52	0.31
7	合计	1,910,711,555.47	100.00

## 10.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	49,105,048.59	2.59
B	采掘业	118,783,487.60	6.26
C	制造业	743,886,224.99	39.20
C0	食品、饮料	138,912,522.06	7.32
C1	纺织、服装、皮毛	47,606,369.13	2.51
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	49,094,351.35	2.59
C5	电子	76,819,913.32	4.05
C6	金属、非金属	31,527,075.48	1.66
C7	机械、设备、仪表	227,933,243.89	12.01
C8	医药、生物制品	171,992,749.76	9.06
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	18,526,366.98	0.98
E	建筑业	32,959,164.60	1.74
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	92,475,638.74	4.87
H	批发和零售贸易	81,851,975.17	4.31
I	金融、保险业	291,431,186.97	15.36
J	房地产业	102,798,403.23	5.42
K	社会服务业	36,243,836.16	1.91
L	传播与文化产业	-	-

M	综合类	-	-
	合计	1,568,061,333.03	82.63

注：以上行业分类以2011年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 10.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	11,033,482	60,904,820.64	3.21
2	601601	中国太保	2,832,904	52,380,394.96	2.76
3	600000	浦发银行	5,842,492	49,894,881.68	2.63
4	600887	伊利股份	2,612,111	47,801,631.30	2.52
5	600518	康美药业	2,867,479	40,574,827.85	2.14
6	002430	杭氧股份	1,685,338	39,099,841.60	2.06
7	000002	万科A	5,366,777	38,855,465.48	2.05
8	000895	双汇发展	590,628	38,390,820.00	2.02
9	000823	超声电子	2,644,822	37,133,300.88	1.96
10	600048	保利地产	3,852,859	35,638,945.75	1.88

### 10.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	48,300,000.00	2.55
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	48,300,000.00	2.55

### 10.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值(元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	1101022	11央行票据22	500,000	48,300,000.00	2.55

### 10.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 10.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 10.8 投资组合报告附注

10.8.1 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

10.8.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

#### 10.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	4,260,759.99

3	应收股利	-
4	应收利息	813,367.72
5	应收申购款	51,246.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,480.68
8	其他	-
9	合计	5,890,854.52

#### 10.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 10.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

### 十三、基金的业绩

基金业绩截至日为 2011 年 9 月 30 日。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

#### 1、本报告期净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

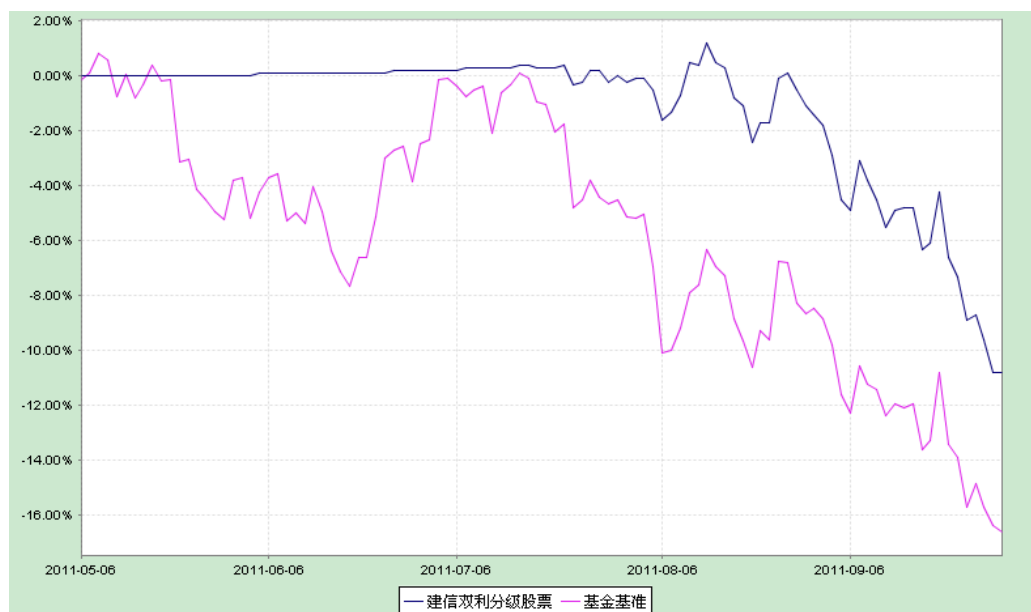
阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2011年5月6日—2011年9月30日	<b>-10.80%</b>	<b>0.63%</b>	<b>-16.59%</b>	<b>1.19%</b>	<b>5.79%</b>	<b>-0.56%</b>
自基金合同生效之日至2011年9月30日	<b>-10.80%</b>	<b>0.63%</b>	<b>-16.59%</b>	<b>1.19%</b>	<b>5.79%</b>	<b>-0.56%</b>

#### 2、自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比

建信双利策略主题分级股票型证券投资基金  
累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的  
历史走势对比图

(2011年5月6日至2011年9月30日)





注：本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

## 十四、基金的财产

### （一）基金财产的构成

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、结算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应计利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、权证投资及其估值调整；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、其他资产等。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管与处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或

者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关法律法规处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十五、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产的价值，并在此基础上计算基金资产净值及建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值。

### （二）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、交易所停止交易等非流通品种的估值。因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （四）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

#### （五）估值程序

1、建信双利基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。建信稳健份额与建信进取份额的份额参考净值精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。

每个工作日计算基金资产净值及建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值后，将建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）基金份额净值的计算

##### 1、建信双利基金份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

$T$  日建信双利基金份额的基金份额净值 =  $T$  日闭市后的基金资产净值 /  $T$  日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金， $T$  日本基金基金份额的总数为建信稳健份额、建信进取份额和建信双利基金份额的份额数之和。

##### 2、建信稳健份额和建信进取份额 $T$ 日的基金份额参考净值计算

$$NAV(A)_T = 1 + \frac{(R + 3.5\%) \times t}{365}$$

$$NAV(B)_T = \frac{[NAV_t - 0.4 \times NAV(A)_T]}{0.6}$$

其中：

$NAV(A)_T$  为  $T$  日建信稳健份额的参考净值；

$NAV(B)_T$  为 T 日建信进取份额的参考净值；

$t = \min\{\text{自年初至 T 日的天数, 自基金合同生效日至 T 日的天数, 自最近一次会计年度内份额不定期折算日至 T 日的天数}\}$ ；

R 为一年期同期银行定期存款利率。

建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### （七）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当建信双利基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）内发生差错时，视为建信双利基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

#### 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任

方对直接损失承担赔偿责任；

若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行



评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4、建信双利基金份额差错处理的原则和方法如下：

(1) 建信双利基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 建信双利基金份额净值的错误偏差达到建信双利基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到建信双利基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

(3) 因建信双利基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## （八）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## （九）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的基金资

产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

## （十）特殊情况的处理

1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十六、基金的收益分配

### （一）收益的构成

本基金合同项下基金收益指基金利润，包括：

- 1、利息收入。
- 2、公允价值变动收入。
- 3、投资收益。
- 4、其他收入。

基金已实现收益为基金利润减去公允价值变动后的余额。因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

基金期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### （二）收益分配原则

本基金不进行收益分配，也不单独对建信稳健份额与建信进取份额进行收益分配。

## 十七、基金份额的折算

### （一）定期份额折算

在建信稳健份额、建信双利基金份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

#### 1、基金份额折算基准日

每个会计年度第一个工作日。

#### 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的建信稳健份额、建信双利基金份额。

#### 3、基金份额折算频率

每年折算一次。

#### 4、基金份额折算方式

建信稳健份额和建信进取份额按照《基金合同》规定的净值计算规则进行净值计算，对建信稳健份额的应得收益进行定期份额折算，每 10 份建信双利基金份额将按 4 份建信稳健份额获得约定应得收益的新增折算份额。

对于建信稳健份额期末的约定应得收益，即建信稳健份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超出本金 1.000 元部分，将折算为场内建信双利基金份额分配给建信稳健份额持有人。建信双利基金份额持有人持有的每 10 份建信双利基金份额将按 4 份建信稳健份额获得新增建信双利基金份额的分配。持有场外建信双利基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外建信双利基金份额的分配；持有场内建信双利基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内建信双利基金份额的分配。经过上述份额折算，建信稳健份额和建信双利基金份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对建信稳健份额和建信双利基金份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行建信稳健份额上一年度应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

(1) 建信稳健份额

$$NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}} = NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}}$$

$$NAV_{\text{稳健}}^{\text{后}} = 1.000\text{元}$$

$$NAV_{\text{双利}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前建信双利基金份额的资产净值} - (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000) \times 4/10 \times NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}$$

$$\text{建信稳健份额持有人新增的场内建信双利份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前建信稳健份额的份额净值

$NAV_{\text{稳健}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后建信稳健份额的份额净值

$NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前建信稳健份额的份额数

$NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后建信稳健份额的份额数

$NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后建信双利基金份额的份额净值

$NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前建信双利基金份额的份额数

建信稳健份额新增份额折算成建信双利基金份额的场内份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

(2) 建信进取份额

每个会计年度的定期份额折算不改变建信进取份额净值及其份额数。

(3) 建信双利基金份额

$$NAV_{\text{双利}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前建信双利基金份额的资产净值} - (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000) \times 4 / 10 \times NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}$$

$$\text{建信双利基金份额持有人新增的建信双利基金份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{双利}}^{\text{前}} \times 4}{10} \times \frac{NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000}{NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后建信双利基金份额的份额数 = 定期份额折算前建信双利基金份额的份额数 + 建信双利基金份额持有人新增的建信双利基金份额的份额数

其中：

$NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前建信稳健份额的份额净值

$NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后建信双利基金份额的份额净值

$NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前建信双利基金份额的份额数

建信双利基金份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；建信双利基金份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前建信双利基金份额的份额净值、建信稳健份额的份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （4）举例

假设本基金成立后第 3 个会计年度第一个工作日为定期份额折算基准日，建信双利基金份额当天折算前资产净值为 7,458,000,000 元。当天场外建信双利基金份额、场内建信双利基金份额、建信稳健份额、建信进取份额的份额数分别为 50 亿份、5 亿份、40 亿份、60 亿份。前一个会计年度末每份建信稳健份额资产净值（建信稳健份额的份额净值）为 1.065000000 元，且未进行不定期份额折算。

A、定期份额折算的对象为基准日登记在册的建信稳健份额和建信双利基金份额，即 40 亿份和 55 亿份。

B、建信稳健份额持有人

折算后持有建信稳健份额=折算前建信稳健份额=40 亿份

$$NAV_{\text{双利}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前建信双利基金份额的资产净值} - (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000) \times 4/10 \times NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}$$

$$= \frac{7,458,000,000 - (1.065000000 - 1.000) \times 4/10 \times 5,500,000,000}{5,500,000,000} = 1.330 \text{元}$$

$$\text{建信稳健份额持有人新增的场内建信双利基金份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}}$$

$$= \frac{4,000,000,000 \times (1.065000000 - 1.000)}{1.330} = 195,488,721.80 \text{份}$$

建信稳健份额新增份额折算成建信双利基金份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产，因此新增建信双利基金份额为 195,488,721 份；持有的建信稳健份额为 40 亿份。

#### C、建信进取份额持有人

本次份额折算不改变建信进取份额净值及其份额数。

#### D、建信双利基金份额持有人

$$\text{场外新增的建信双利基金份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{双利}}^{\text{前}} \times 4}{10} \times \frac{NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000}{NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}}$$

$$= \frac{5,000,000,000 \times 4}{10} \times \frac{1.065000000 - 1.000}{1.330} = 97,744,360.90 \text{份}$$

定期份额折算后场外建信双利基金份额的份额数=定期份额折算前场外建信双利基金份额的份额数+场外新增的建信双利基金份额  
=5,000,000,000+97,744,360.90 =5,097,744,360.90 份

$$\text{场内新增的建信双利基金份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{双利}}^{\text{前}} \times 4}{10} \times \frac{NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000}{NAV_{\text{双利}}^{\text{后}}}$$

$$= \frac{500,000,000 \times 4}{10} \times \frac{1.065000000 - 1.000}{1.330} = 9,774,436.09 \text{份}$$

取整后为 9,774,436 份，定期份额折算后场内建信双利基金份额的份额数=定期份额折算前场内建信双利基金份额的份额数+场内新增的建信双利基金份额=500,000,000+9,774,436 =509,774,436 份

#### 5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停建信稳健份额与建信进取份额的上市交易和建信双利基金份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告折算结果，并报中国证监会备案。

#### 7、特殊情形的处理

若在某会计年度最后一个工作日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

## （二）不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当建信双利基金份额的基金份额净值达到 2.000 元；当建信进取份额的基金份额净值达到 0.200 元。

#### 1、不定期折算情形一：

当建信双利基金份额的基金份额净值达到 2.000 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

##### （1）基金份额折算基准日

建信双利基金份额的基金份额净值达到 2.000 元时，基金管理人即可确定折算基准日。

##### （2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的建信稳健份额、建信进取份额和建信



双利基金份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当建信双利基金份额的基金份额净值达到 2.000 元后,本基金将分别对建信稳健份额、建信进取份额和建信双利基金份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保建信稳健份额和建信进取份额的比例为 4:6,份额折算后建信稳健份额、建信进取份额和建信双利基金份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

建信稳健份额、建信进取份额、建信双利基金份额三类份额按照如下公式进行份额折算:

① 建信稳健份额

份额折算原则:

A、份额折算前建信稳健份额的份额数与份额折算后建信稳健份额的份额数相等;

B、建信稳健份额持有人份额折算后获得新增的份额数,即超出 1.000 元以上的净值部分全部折算为场内建信双利基金份额。

$$NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}} = NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}}$$

$$\text{建信稳健份额持有人新增的场内建信双利份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中:

$NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}}$ : 份额折算前建信稳健份额净值

$NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}}$ : 份额折算前建信稳健份额的份额数

$NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}}$ : 份额折算后建信稳健份额的份额数

② 建信进取份额

份额折算原则：

A、份额折算后建信进取份额与建信稳健份额保持 4：6 配比；

B、份额折算前建信进取份额的资产与份额折算后建信进取份额的资产及其新增场内建信双利基金份额的资产之和相等；

C、份额折算前建信进取份额的持有人在份额折算后将持有建信进取份额与新增场内建信双利基金份额。

$$NUM_{\text{进取}}^{\text{后}} = NUM_{\text{进取}}^{\text{前}}$$

$$\text{建信进取份额持有人新增的场内建信双利份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{进取}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{进取}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NAV_{\text{进取}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信进取份额净值

$NUM_{\text{进取}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信进取份额的份额数

$NUM_{\text{进取}}^{\text{后}}$ ：份额折算后建信进取份额的份额数

### ③ 建信双利基金份额

份额折算原则：

场外建信双利基金份额持有人份额折算后获得新增场外建信双利基金份额，场内建信双利基金份额持有人份额折算后获得新增场内建信双利基金份额。

$$NUM_{\text{双利}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{双利}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NAV_{\text{双利}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信双利基金份额的份额净值

$NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信双利基金份额的份额数

$NUM_{\text{双利}}^{\text{后}}$ : 份额折算后建信双利基金份额的份额数

建信双利基金份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；建信双利基金份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额净值、建信进取份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### ④ 举例

某投资者持有建信双利基金份额、建信稳健份额、建信进取份额各为10,000份、4,000份、6,000份，在本基金的不定期份额折算日，三类份额的基金份额净值如下表所示，折算后，建信双利基金份额、建信稳健份额、建信进取份额三类基金份额净值均调整为1.000元。

	折算前		折算后	
	基金份额净值(元)	基金份额	基金份额净值(元)	基金份额
建信双利基金份额	2.020000000	10,000份	1.000	20,200份建信双利基金份额
建信稳健份额	1.018000000	4,000份	1.000	4,000份建信稳健份额+新增72份场内建信双利基金份额
建信进取份额	2.688000000	6,000份	1.000	6,000份建信进取份额+新增10128份场内建信双利基金份额

#### (5) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停建信稳健份额与建信进取份额的上市交易和建信双利基金份额的申购或赎回相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### (6) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告折算结果，并报中国证监会备案。

### 2、不定期折算情形二：

当建信进取份额的基金份额净值达到 0.200 元, 本基金将按照以下规则进行份额折算。

(1) 基金份额折算基准日

建信进取份额的基金份额净值达到 0.200 元, 基金管理人即可确定折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的建信稳健份额、建信进取份额、建信双利基金份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当建信进取份额的基金份额净值达到 0.200 元后, 本基金将分别对建信稳健份额、建信进取份额和建信双利基金份额进行份额折算, 份额折算后本基金将确保建信稳健份额和建信进取份额的比例为 4: 6, 份额折算后建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

建信稳健份额、建信进取份额、建信双利基金份额三类份额按照如下公式进行份额折算。

① 建信进取份额

份额折算原则:

份额折算前建信进取份额的资产与份额折算后建信进取份额的资产相等。

$$NUM_{\text{进取}}^{\text{后}} = \frac{NUM_{\text{进取}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{进取}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中:

$NAV_{\text{进取}}^{\text{前}}$ : 份额折算前建信进取份额净值

$NUM_{\text{进取}}^{\text{前}}$ : 份额折算前建信进取份额的份额数

$NUM_{\text{进取}}^{\text{后}}$ ：份额折算后建信进取份额的份额数

② 建信稳健份额

份额折算原则：

A、份额折算前后建信稳健份额与建信进取份额始终保持 4：6 配比；

B、份额折算前建信稳健份额的资产与份额折算后建信稳健份额的资产及其新增场内建信双利基金份额的资产之和相等；

C、份额折算前建信稳健份额的持有人在份额折算后将持有建信稳健份额与新增场内建信双利基金份额。

$$NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}} = \frac{NUM_{\text{进取}}^{\text{后}}}{6} \times 4$$

$$NUM_{\text{双利}}^{\text{场内}} = \frac{NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}} - NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中：

$NAV_{\text{稳健}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信稳健份额净值

$NUM_{\text{稳健}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信稳健份额的份额数

$NUM_{\text{稳健}}^{\text{后}}$ ：份额折算后建信稳健份额的份额数

$NUM_{\text{进取}}^{\text{后}}$ ：份额折算后建信进取份额的份额数

$NUM_{\text{双利}}^{\text{场内}}$ ：份额折算前建信稳健份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内建信双利基金份额的份额数

③ 建信双利基金份额：

份额折算原则：

份额折算前建信双利基金份额的资产与份额折算后建信双利基金份额

的资产相等。

$$NUM_{\text{双利}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{双利}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NAV_{\text{双利}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信双利基金份额的份额净值

$NUM_{\text{双利}}^{\text{前}}$ ：份额折算前建信双利基金份额的份额数

$NUM_{\text{双利}}^{\text{后}}$ ：份额折算后建信双利基金份额的份额数

建信双利基金份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；建信双利基金份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前建信双利基金份额的基金份额净值、建信稳健份额净值、建信进取份额净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### ④ 举例

某投资者持有建信双利基金份额、建信稳健份额、建信进取份额为10,000份、4,000份、6,000份，在本基金的不定期份额折算日，三类份额的基金份额净值如下表所示，折算后，建信双利基金份额、建信稳健份额、建信进取份额三类基金份额净值均调整为1.000元。

	折算前		折算后	
	基金份额净值(元)	基金份额	基金份额净值(元)	基金份额
建信双利基金份额	0.526000000	10,000份	1.000	5,260份建信双利基金份额
建信稳健份额	1.018000000	4,000份	1.000	792份建信稳健份额+新增3,280份场内建信双利基金份额
建信进取份额	0.198000000	6,000份	1.000	1,188份建信进取份额

#### (5) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳

证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停建信稳健份额与建信进取份额的上市交易和建信双利基金份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(6) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告折算结果，并报中国证监会备案。

## 十八、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金上市费用；
- 4、基金财产划拨支付的银行费用；
- 5、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值



基金托管费每日计提，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### **（四）不列入基金费用的项目**

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

**（五）**基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 个工作日前在指定媒体上刊登公告。

#### **（六）基金税收**

本基金运作过程中的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规履行。

## 十九、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
- 3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### （二）基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在2个工作日内指定媒体上公告。

## 二十、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

### （一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

## （二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## （三）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## （四）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## （五）建信稳健份额与建信进取份额上市交易公告书

本基金建信稳健份额与建信进取份额获准在证券交易所上市交易后，基金管理人将在上市交易 3 个工作日前，将建信稳健份额与建信进取份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## （六）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1、本基金的基金合同生效后，在开始办理建信双利基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和建信双利基金份

额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值；

2、在开始办理建信双利基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值、建信进取份额参考净值和建信双利基金份额累计净值；

3、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值、建信进取份额参考净值和建信双利基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

### **（七）建信双利基金份额申购、赎回价格公告**

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明建信双利基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

### **（八）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告**

1、基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2、基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3、基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；

4、基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5、基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

## （九）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决议；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、建信双利基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加或减少代销机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、建信双利基金份额开始办理申购、赎回；

- 22、建信双利基金份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、建信双利基金份额发生巨额赎回并延期支付；
- 24、建信双利基金份额连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、建信双利基金份额暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、本基金接受或暂停接受配对转换申请；
- 27、本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
- 28、本基金实施基金份额折算；
- 29、建信稳健份额、建信进取份额暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 30、中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

### （十）澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

### （十一）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

### （十二）中国证监会规定的其他信息。

### （十三）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、建信双利基金份额净值、

建信稳健份额参考净值、建信进取份额参考净值、建信双利基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金托管人在基金年度报告、半年度报告等信息披露文件中出具基金托管人报告。托管人报告应说明基金托管人和基金管理人履行基金合同的情况。

基金管理人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

#### **（十四）信息披露文件的存放与查阅**

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。



## 二十一、风险揭示

基金风险即基金收益的不确定性，所有可能影响基金业绩的因素都属于风险的来源，而风险管理本质上就是在一定约束条件下对预期收益和预期风险的平衡。科学严谨的风险管理对基金投资管理绩效至关重要，与投资者利益休戚相关，因此对风险的识别、评估和控制应贯穿基金投资的全过程。

本基金面临的风险主要有以下方面：

### （一）系统性风险

本基金投资于证券市场，系统性风险是指因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的风险，主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险和购买力风险等。

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策和法律法规的变化对证券市场产生一定影响，从而导致市场价格波动，影响基金收益而产生的风险。

#### 2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，经济运行周期性的变化会对基金所投资的证券的基本面产生影响，从而影响证券的价格而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率的波动会直接导致股票市场的价格和收益率变动，同时也影响到证券市场资金供求状况，以及上市公司的融资成本和利润水平。上述变化将直接影响证券价格和本基金的收益。

#### 4、债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险。

#### 5、再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升带来的价格风险互为消长。

## （二）非系统性风险

非系统性风险是指个别证券特有的风险，包括上市公司经营风险、信用风险等。

### 1、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理层能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，将导致其股票价格下跌或股息、红利减少，从而使基金投资收益下降。本基金可以通过多样化投资来分散这种非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

### 2、信用风险

信用风险指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

## （三）流动性风险

本基金类型为契约型开放式，基金规模将随着基金投资人对基金份额的申购和赎回而波动，基金投资人的连续大量赎回申请产生的仓位调整可能使资产难以按照预先期望的成交价格变现而导致基金的投资组合流动性不足；或者投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低，造成基金资产变现的损失，从而产生流动性风险。

## （四）基金管理风险

基金管理风险指基金管理人在基金管理实施过程中产生的风险，主要包括以下几种：

### 1、管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险。或公司内部失控而导致基金财产损失的风险。

## 2、交易风险

在基金投资交易过程中由于各种原因造成的风险。

## 3、运营风险

由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障等情况而造成的风险，或者由于操作过程中的疏忽和错误而产生的风险。

## 4、道德风险

因业务人员道德行为违规产生的风险，如内幕交易，欺诈行为等。

## （五）本基金的特定风险

### 1、股票投资风险

本基金为股票型基金，投资于证券市场，在具体投资管理中，本基金可能面临特定类型股票所具有的特有风险，也可能由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。

从资产整体运作来看，本基金为股票型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险、较高收益的股票型基金品种。

### 2、基金运作的特有风险

#### （1）杠杆性风险

建信进取份额具有一定的杠杆性，因此，建信进取份额表现出比一般股票型份额更高的风险特征，其净值变动的波动性要高于其他两类份额。

#### （2）不进行收益分配的风险

在基金存续期内，本基金不进行收益分配，也不单独对建信稳健份额与建信进取份额进行收益分配。

在基金折算日，基金管理人将根据《基金合同》中的约定对本基金的各项份额进行折算，之后投资者可通过卖出建信稳健份额、建信进取份额或按比例合并建信稳健份额、建信进取份额后赎回来获取投资回报。

但是，投资者通过上述方式获取投资回报不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

#### （3）场内份额配对转换的风险

在满足场内份额配对转换的条件下，本基金份额持有人可办理场内份

额配对转换业务。一方面，可能改变建信稳健份额与建信进取份额的市场供求关系，从而可能影响基金份额的交易价格；另一方面，可能出现暂停办理该业务的情形，投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

#### （4）上市交易风险

建信稳健份额与建信进取份额在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖建信稳健份额与建信进取份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致建信稳健份额与建信进取份额产生流动性风险。

#### （5）基金份额折算的风险

##### 1) 在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失

场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为1份），整数位以后部分采取截位法，余额计入基金财产。因此，在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

2) 由于本基金各级份额的风险收益特征不同，在本基金进行份额折算后，基金份额持有人所持有的基金份额将面临风险收益特征变化的风险。

（6）本基金的基金份额转托管、场内基金份额配对转换等业务过程中，一些券商可能由于其自身原因限制，存在无法进行场内交易的风险。

#### （7）基金份额的折/溢价交易风险

建信稳健份额与建信进取份额上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额参考净值可能出现偏离并出现折/溢价风险。尽管份额配对转换套利机制的设计已将建信稳健份额与建信进取份额的折/溢价风险降至较低水平，但是该制度不能完全规避该风险的存在。

### （六）其他风险

主要是由其他不可预见或不可抗力因素导致的风险，如战争、自然灾害等有可能导致基金财产损失或影响基金收益水平。

## 二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

- （1）转换基金运作方式；
- （2）变更基金类别；
- （3）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- （4）变更基金份额持有人大会程序；
- （5）更换基金管理人、基金托管人；
- （6）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- （9）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- （2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- （3）因相应的法律法规及交易所的有关规则发生变动必须对基金合同进行修改；
- （4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准

或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

## （二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4、法律法规及中国证监会规定的其它情况。

## （三）基金财产的清算

### 1、基金财产清算组

（1）基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### 2、基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- （2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （3）对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行估价和变现；
- （5）基金财产清算组制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

- (7) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (8) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配；
- (11) 基金财产清算的期限为 6 个月。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 4、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自的应计分配比例，并据此向建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十三、基金合同的内容摘要

### (一) 基金合同当事人及权利义务

#### 1、基金管理人

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：江先周

成立时间：2005年9月19日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2005]158号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2亿元

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人

名称：招商银行股份有限公司（简称：招商银行）

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：傅育宁

成立时间：1987年4月8日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2002]83号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。



组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 215.77 亿元

存续期间：持续经营

### 3、基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

### 4、基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- (1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- (2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- (3) 发售基金份额；
- (4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (5) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- (6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- (7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- (8) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- (9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

- (10) 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- (11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (13) 依法召集基金份额持有人大会；
- (14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 5、基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 计算并公告建信双利基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的份额参考净值，确定建信双利基金份额申购、赎回价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制中期和年度基金报告；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露

及报告义务；

- (14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- (16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- (23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## 6、基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

- (1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门

- 批准的其他收入；
- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
  - (3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
  - (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
  - (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会；
  - (6) 依法召集基金份额持有人大会；
  - (7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；
  - (8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 7、基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (12) 复核、审查基金管理人计算的建信双利基金份额净值、建信稳健份额与建信进取份额的份额参考净值和建信双利基金份额申购、赎回价格；
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (19) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## 8、基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让其持有的建信稳健份额与建信进取份额，依法申请赎

回其持有的建信双利基金份额；

- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

## 9、基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金、基金合同其他当事人及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

10、本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

### (二) 基金份额持有人大会

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额持有人独立进行表决。基

金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

## 2、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 提前终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 5) 变更基金份额持有人大会程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- 8) 本基金与其他基金的合并；
- 9) 单独或合计持有建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- 10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用，法律法规要求增加基金费用收取；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更收费方式、调整建信双利基金份额的申购费率、调低赎回费率；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；

基金管理人决定不召集，基金托管人就同一事项仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 单独或合计代表建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(4) 单独或合计代表建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理



人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

#### 4、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- 6) 代理投票的授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- 7) 表决方式；
- 8) 会务常设联系人姓名、电话；
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 10) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### 5、基金份额持有人出席会议的方式

### (1) 会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4) 会议的召开方式由召集人确定。

### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

#### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

a、对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额应占权益登记日各自基金份额的 50%以上（含 50%）；

b、到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

#### 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

a、召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

b、召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

c、召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

d、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额占权益登记日各自基金份额的 50%以上（含 50%）；

e、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

## 6、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分类表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合并持有权益登记日建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后, 如果需要对原有提案进行修改, 应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则, 会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项, 确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后进行表决, 经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的, 其授权代表未能主持大会的情况下, 由基金托管人授权代表主持; 如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会, 则由出席大会的建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自基金份额持有人所持表决权的 50%以上 (含 50%) 选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名 (或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名 (或单位名称) 等事项。

### 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下, 首先由召集人提前 30 日公布提案, 在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督, 则在公证机关监督下形成的决议有效。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

### 1) 一般决议

一般决议须经出席会议的建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额持有人 (或其代理人) 各自所持表决权的 50% 以上 (含 50%) 通过方

为有效，除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；法律法规另有规定时，从其规定。

## 2) 特别决议

特别决议须经出席会议的建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额持有人（或其代理人）各自所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

（3）基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

（4）采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（5）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（6）基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 8、计票

### （1）现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人共同授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；

如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权三名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

(2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

10、法律法规或中国证监会对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## (三) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 1、基金合同的变更

(1) 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

1) 转换基金运作方式；

2) 变更基金类别；

- 3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
- 4) 变更基金份额持有人大会程序;
- 5) 更换基金管理人、基金托管人;
- 6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外;
- 7) 本基金与其他基金的合并;
- 8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
- 9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意变更后公布,并报中国证监会备案:

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式;
- 3) 因相应的法律法规及交易所的有关规则发生变动必须对基金合同进行修改;
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行,并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

## 2、本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的;
- (2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;
- (3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;

(4) 法律法规及中国证监会规定的其他情况。

### 3、基金财产的清算

#### (1) 基金财产清算组

1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### (2) 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 基金财产清算组制作清算报告；
- 6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 8) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- 9) 公布基金财产清算结果；
- 10) 对基金剩余财产进行分配；
- 11) 基金财产清算的期限为 6 个月。

#### (3) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

#### (4) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；



- 3) 清偿基金债务；
- 4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)－3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自的应计分配比例，并据此向建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

#### (5) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### (6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### (四) 争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

### (五) 基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

## 二十四、基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1. 基金管理人

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：江先周

成立时间：2005年9月19日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2005]158号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

#### 2. 基金托管人

名称：招商银行股份有限公司(简称：招商银行)

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：傅育宁

成立时间：1987年4月8日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2002]83号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买

卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 215.77 亿元

存续期间：持续经营

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规和监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

对基金管理人发送的不符合基金合同规定的投资行为，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资，基金托管人发现该投资行为不符合基金合同的规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

本基金为股票型基金，基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0-3%；固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金投资组合遵循以下投资限制：

- (1) 本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%-95%；
- (2) 本基金持有的固定收益类证券和现金占基金资产的比例为 5%—10%；
- (3) 本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- (4) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (6) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- (7) 本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- (8) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (9) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (10) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%； 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (12) 本基金持有的债券其信用级别不低于 BBB 级；

(13) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(14) 法律法规及中国证监会规定的其他限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定, 履行适当程序后, 本基金不受上述规定的限制。

基金托管人对基金的投资的监督与核查自基金合同生效之日起开始。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述约定比例的, 不在限制之内, 但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整, 以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后的监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定, 基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性, 并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时, 如基金托管人提醒基金管理人后仍无法阻止关联交易发生时, 基金托管人有权向中国证监会报告。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人, 否则由此造成的损失应由基金管理人承担。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交

易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单，但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5、本基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(1) 本协议所称的流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

本基金可以投资经中国证监会批准的非公开发行证券，且限于由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管的，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行证券。

基金参与非公开发行证券的认购，不得预付任何形式的保证金，法律法规或中国证监会另有规定的除外。

基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券，且锁定期不得超过本基金的剩余期限。

(2) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流

程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。

(3) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、应划付的认购款、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

由于基金管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息，致使托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的，基金托管人免于承担责任。

(4) 基金托管人依照法律法规，《基金合同》，《托管协议》审核基金管理人投资流通受限证券的行为。如发现基金管理人违反了《基金合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定，应及时通知基金管理人，并呈报中国证监会，同时采取合理措施保护基金投资人的利益。基金托管人有权对基金管理人的违法、违规以及违反《基金合同》、《托管协议》投资指令不予执行，并立即通知基金管理人纠正，基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得不执行时，基金托管人应向中国证监会报告。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、建信双利基金份额净值计算、建信稳健份额参考净值与建信

进取份额参考净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人，对于收到的书面通知基金管理人应以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

8、基金管理人应义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。包括但不限于：对基金托管人发出的提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9、若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人及时纠正，由此造成的损失由基金管理人承担。

10、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### （三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。



2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到书面通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。

3、基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查，包括但不限于：对基金管理人发出的书面提示，基金托管人应在规定时间内答复并改正，或就基金管理人的疑义进行解释或举证；基金托管人应积极配合提供相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性。

4、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

#### （四）基金财产的保管

##### 1、基金财产保管的原则

- （1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- （2）基金托管人应安全保管基金财产。
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- （4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- （5）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。
- （6）对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措

施进行催收。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。

- (7) 基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失，基金托管人不承担责任。除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## 2、基金募集期间及募集资金的验资

- (1) 基金募集期间募集的资金应开立“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。
- (2) 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额（包括建信双利基金份额、建信稳健份额及建信进取份额）、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，基金管理人应聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。
- (3) 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

## 3、基金银行账户的开立和管理

- (1) 基金托管人以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，保管基金的银行存款，并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人刻制、保管和使用。
- (2) 基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。
- (3) 基金银行账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

#### 4、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

- (1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。
- (2) 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。
- (3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。
- (4) 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。
- (5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开立和管理

- (1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和基金合同的约定开立。新账户按有关规定使用并管理。
- (2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库，或存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本的原件送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。因基金托管人原因造成该等合同遗失或基金托管人将自己保管的本基金重大合同在未经基金管理人同意的情况下，用于抵押、质押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成基金资产损失，由基金托管人承担相应的法律责任并赔偿损失。

### （五）基金资产净值计算和会计核算

#### 1、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

##### （1）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值，经基金托管人复核，按规定公告。

##### （2）复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将建信双利基金份额净值、建信稳健份额参考净值与建信进取份额参考净值结果发送基金托管人，

经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

(3) 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 2、基金资产估值方法和特殊情形的处理

### (1) 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### (2) 估值方法

#### a、证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技

术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

b、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

c、交易所停止交易等非流通品种的估值。因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

d、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

e、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

f、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

g、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### 3、估值错误的处理方式

(1) 当建信双利基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错

时，视为建信双利基金份额净值错误；建信双利基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；建信双利基金份额净值错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；建信双利基金份额净值错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告；当建信双利基金份额发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当建信双利基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

② 若基金管理人计算的建信双利基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人及基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③ 如基金管理人和基金托管人对建信双利基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对或对基金管理人采用的估值方法，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④ 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致建信双利基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的建信双利

基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### 4、暂停估值与公告基金份额净值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

(3) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；

(4) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

### (六) 基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称、证件号码和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金管理人和托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

### (七) 争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲



裁委员会，仲裁地点为北京，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## （八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

### 2、基金托管协议终止出现的情形

- （1）基金合同终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

### 3、基金财产的清算

#### （1）基金财产清算组

1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

3) 在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

4) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### (2) 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 基金财产清算组制作清算报告；
- 6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 8) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- 9) 公布基金财产清算结果；
- 10) 对基金剩余财产进行分配；
- 11) 基金财产清算的期限为 6 个月。

#### (3) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

#### (4) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)－3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自的应计分配比例，并据此向建信双利基金份额、建信稳健份额与建信进取份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

#### （5）基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### （6）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十五、对基金份额持有人的服务

基金管理人秉承“持有人利益重于泰山”的经营宗旨，不断完善客户服务体系。公司承诺为客户提供以下服务，并将随着业务发展和客户需求的变化，积极增加服务内容，努力提高服务品质，为客户提供专业、便捷、周到的全方位服务。

(一) 客户服务热线：400-81-95533（免长途通话费用）、010-66228000

### 1、自助语音服务

客户服务中心提供每周 7 天，每天 24 小时的自动语音服务，内容包括：基金净值查询、账户信息查询、公司信息查询、基金信息查询等。

### 2、人工咨询服务

客户服务中心提供每周一至周五，上午 9：00～11：30，下午 13：00～17：00 的人工电话咨询服务。

### 3、客户留言服务

投资者可通过客户留言服务将其疑问、建议及联系方式告知公司客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

(二) 邮寄服务

1、场外投资者：若投资者准确完整的预留了地址及邮编，本基金管理人将提供以下邮寄服务：

#### (1) 账户确认书

客户服务中心于投资者开户确认后，在 15 个工作日内安排寄出。

#### (2) 交易对账单

客户服务中心于每季度结束后，在 15 个工作日内安排为基金持有人寄出。

#### (3) 对账单补寄

客户服务中心于投资者提出补寄需求后，在 15 个工作日内安排寄出。

#### (4) 其他相关信息资料

为加强与客户沟通，使投资者及时了解公司最新动态及产品信息，客户服务中心将不定期为客户寄送相关信息资料。

## 2、场内投资者

每次交易结束后，可在 T+1 个工作日后到交易网点进行确认单的查询和打印，注册登记机构和基金管理人不会寄送场内投资者的对账单，投资者可随时到交易网点打印或通过交易网点提供的自助、电话、网上服务手段查询。

### （三）网站服务（www.ccbfund.cn）

1、信息查询：客户可通过网站查询基金净值、产品信息、建信资讯、公司动态及相关信息等。

2、账户查询：投资者可通过网上“账户查询”服务查询场外账户信息，查询内容包括份额查询、交易查询、分红查询、分红方式查询等；同时投资者还可通过“账户查询修改”、“查询密码修改”自助修改基本信息及查询密码。

3、投资流程：直销客户可了解直销柜台办理各项业务的具体流程。

4、单据下载：直销客户可方便快捷的下载各类直销表单。

5、销售网点：客户可全面了解基金的销售网点信息。

6、常见问题：汇集了客户经常咨询的一些热点问题，帮助客户更好的了解基金基础知识及相关业务规则。

7、客户留言：通过网上客户留言服务，可将投资者的疑问、建议及联系方式告知客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

### （四）短信服务

1、若场外投资者准确完整的预留了手机号码（小灵通用户除外），可获得免费手机短信服务，包括产品信息、基金分红提示、公司最新公告等。未预留手机号码的投资者可拨打客服电话或登陆公司网站添加后定制此项服务。

2、短信对账单：短信对账单是通过手机短信向基金份额持有人提供份额对账的一种电子化的账单形式。短信对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值等。我公司在每月度结束后 10 个工作日内向每位预留了有效手机号码并成功定制短信对账单服务的场外持有人发送短信对账单。

### （五）电子对账单服务

电子对账单是通过电子邮件向基金份额持有人提供交易对账的一种电子化的账单形式。电子对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值、期间交易明细、分红信息等。

我公司在每月度结束后10个工作日内向每位预留了有效电子邮箱并成功订制电子对账单服务的场外持有人发送电子对账单。

#### （六）密码解锁/重置服务

为保证投资者账户信息安全，当拨打客服电话或登陆公司网站查询个人账户信息，输入查询密码错误累计达6次账户即被锁定。此时可致电客服电话转人工办理查询密码的解锁或重置。

#### （七）客户建议、投诉处理

投资者可以通过网站客户留言、客服中心自动语音留言、客服中心人工坐席、书信、传真等多种方式对基金管理人提出建议或投诉，客服中心将在两个工作日内给予回复。

## 二十六、其他应披露事项

### (一) 基金管理人发布的临时公告

自 2011 年 5 月 6 日至 2011 年 11 月 5 日,本基金的临时公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)。

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增申银万国证券为旗下开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-08-24
2	关于建信基金管理有限责任公司与中国建设银行股份有限公司之间发生的关联交易的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-08-23
3	关于旗下部分开放式基金通过长江证券开办基金定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-08-05
4	关于旗下部分开放式基金参加长江证券网上交易及手机证券交易系统基金申购(含定投)费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-08-05
5	建信基金管理有限责任公司关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-08-04
6	关于开展建设银行借记卡网上直销申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-07-28
7	关于开通汇付天下“天天盈”账户网上直销业务并实施费率优惠的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-07-15
8	关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行及手机银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-28

9	关于开通建设银行借记卡基金网上交易业务并实施费率优惠的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-28
10	关于旗下部分开放式基金通过中国工商银行开办基金定投业务暨参加基金定投优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-16
11	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之建信稳健与建信进取基金份额上市交易提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-08
12	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-02
13	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之建信稳健与建信进取基金份额上市交易公告书	指定报刊和/或公司网站	2011-06-02
14	关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金开通系统内转托管和跨系统转托管业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-05-31
15	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊和/或公司网站	2011-05-07

投资者可通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn) 查阅上述公告。

## （二）基金托管人发布的临时公告

招商银行股份有限公司于2011年7月29日在《证券时报》上发布《关于招商银行股份有限公司总行资产托管部夏博辉同志通知离任公告》



## 二十七、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买本招募说明书的复制件或复印件。投资人按上述方式所获得的文件或其复印件。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十八、备查文件

- 1.中国证监会核准建信双利策略主题分级股票型证券投资基金募集的文件
- 2.《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》
- 3.《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金托管协议》
- 4.关于申请募集建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之法律意见书
- 5.基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6.基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7.中国证监会要求的其他文件

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

建信基金管理有限责任公司

二〇一一年十二月十四日